

泓德裕康债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年1月1日起至2026年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	68
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	69
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	69
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12 投资组合报告附注	69
§8 基金份额持有人信息	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	73
§9 开放式基金份额变动	74
§10 重大事件揭示	74
10.1 基金份额持有人大会决议	74
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
10.4 基金投资策略的改变	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	75
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	75
10.8 其他重大事件	79
§11 影响投资者决策的其他重要信息	80
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§12 备查文件目录	80
12.1 备查文件目录	80
12.2 存放地点	80
12.3 查阅方式	80

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德裕康债券型证券投资基金		
基金简称	泓德裕康债券		
基金主代码	002738		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016年07月15日		
基金管理人	泓德基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,303,208,581.25份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	泓德裕康债券A	泓德裕康债券C	泓德裕康债券D
下属分级基金的交易代码	002738	002739	026970
报告期末下属分级基金的份额总额	1,167,075,529.59份	51,022,004.15份	85,111,047.51份

注：本基金于2026年3月12日新增D类基金份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持基金资产流动性前提下，通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、固定收益投资策略、权益投资策略及国债期货投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合资产的增值。其中，本基金将采用"自上而下"的分析方法,综合分析宏观经济周期与形势、货币政策、财政政策、利率走势、资金供求、流动性风险、信用风险等因素，分析比较各大类资产的收益风险特征，在基准配置比例的基础上，动态调整各大类资产的投资比例，控制投资组合的系统性风险。

业绩比较基准	中国债券综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泓德基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李娇	郭明
	联系电话	010-59850151	010-66105799
	电子邮箱	lijiao@hongdefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-100-888	95588
传真		010-59850195	010-66105798
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区北京大道柳梧城投大厦A-120 6-1	北京市西城区复兴门内大街5 5号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街1 25号	北京市西城区复兴门内大街5 5号
邮政编码		100088	100140
法定代表人		王德晓	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金中期报告置备地点	北京市西城区德胜门外大街125号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泓德基金管理有限公司	北京市西城区德胜门外大街125号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)		
	泓德裕康债 券A	泓德裕康债 券C	泓德裕康债 券D
本期已实现收益	31,895,772.79	1,792,345.78	-62,747.14
本期利润	45,563,146.03	1,460,354.81	731,487.71
加权平均基金份额本期利润	0.0361	0.0203	0.0308
本期加权平均净值利润率	2.56%	1.49%	2.17%
本期基金份额净值增长率	2.69%	2.51%	0.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)		
期末可供分配利润	289,198,922.69	10,265,069.10	35,589,143.39
期末可供分配基金份额利润	0.2478	0.2012	0.4181
期末基金资产净值	1,661,407,666.77	70,093,257.64	121,198,566.53
期末基金份额净值	1.4236	1.3738	1.4240
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	58.43%	53.10%	0.74%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金自2026年3月12日起增设D类基金份额类别。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泓德裕康债券A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	2.12%	0.27%	1.74%	0.14%	0.38%	0.13%
过去六个月	2.69%	0.28%	1.62%	0.12%	1.07%	0.16%
过去一年	7.88%	0.24%	1.98%	0.11%	5.90%	0.13%
过去三年	16.10%	0.30%	7.80%	0.11%	8.30%	0.19%
过去五年	10.87%	0.28%	7.84%	0.11%	3.03%	0.17%
过去七年	38.37%	0.28%	13.34%	0.12%	25.03%	0.16%
自基金合同 生效起至今	58.43%	0.27%	15.41%	0.12%	43.02%	0.15%

泓德裕康债券C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	2.03%	0.27%	1.74%	0.14%	0.29%	0.13%
过去六个月	2.51%	0.28%	1.62%	0.12%	0.89%	0.16%
过去一年	7.50%	0.24%	1.98%	0.11%	5.52%	0.13%
过去三年	14.88%	0.30%	7.80%	0.11%	7.08%	0.19%
过去五年	8.94%	0.28%	7.84%	0.11%	1.10%	0.17%
过去七年	35.12%	0.28%	13.34%	0.12%	21.78%	0.16%
自基金合同 生效起至今	53.10%	0.27%	15.41%	0.12%	37.69%	0.15%

泓德裕康债券D

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差④		
过去三个月	2.12%	0.27%	1.74%	0.14%	0.38%	0.13%
自基金合同生效起至今	0.74%	0.30%	1.30%	0.14%	-0.56%	0.16%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

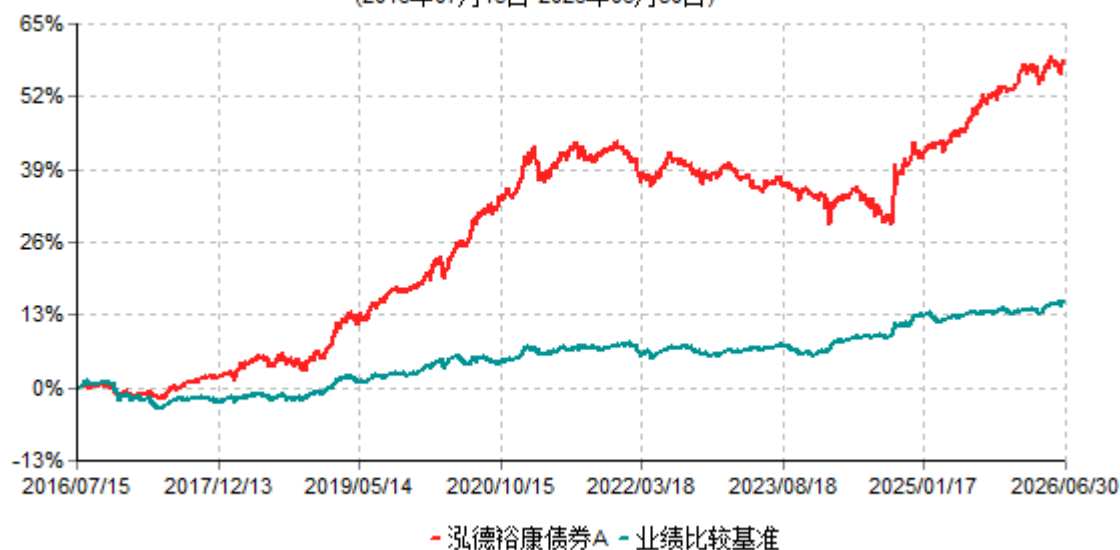
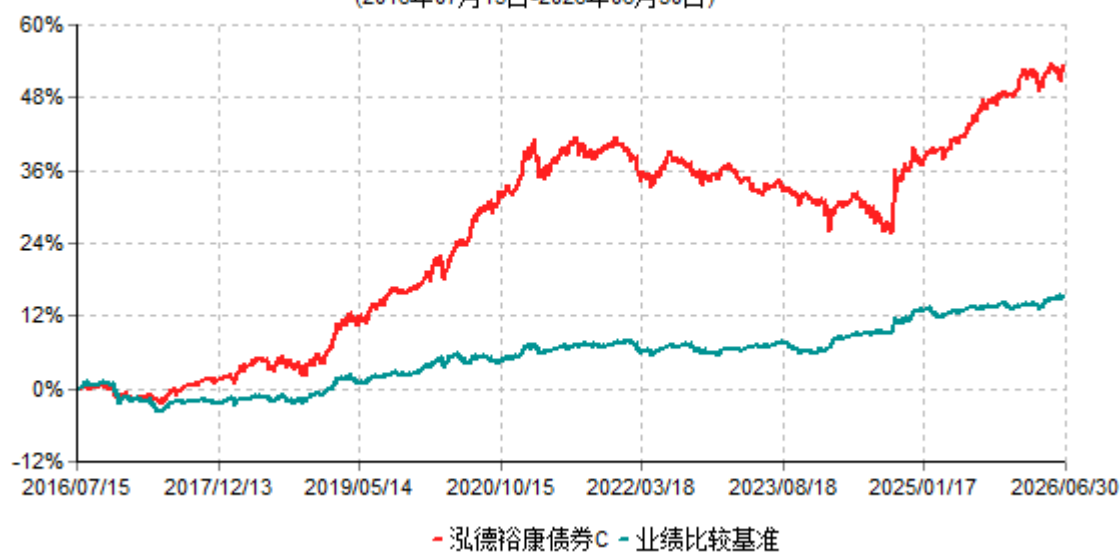
本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%

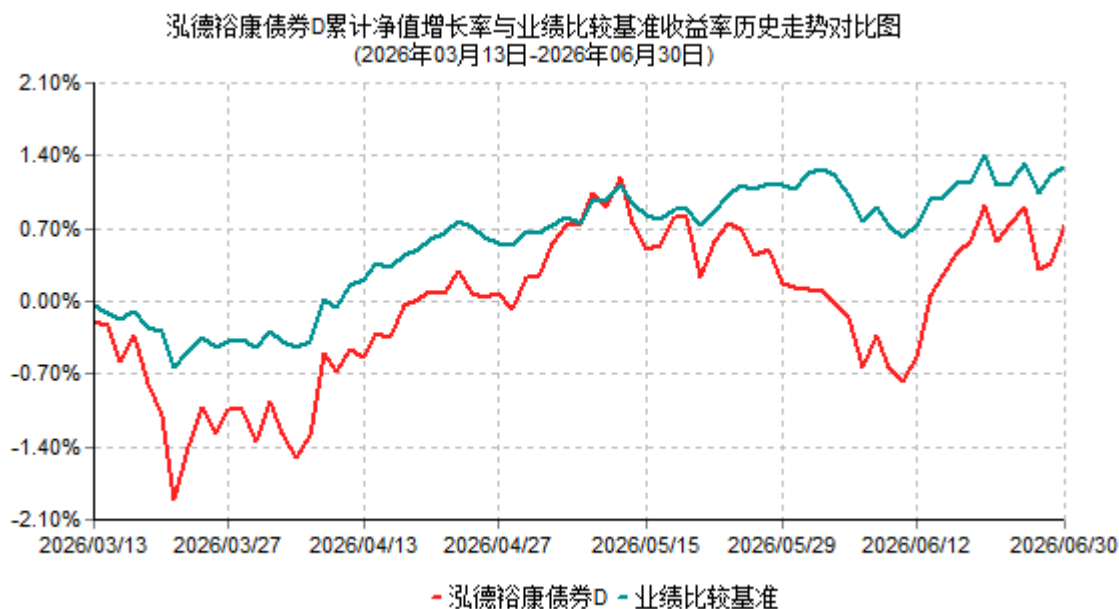
(1)中国债券综合全价指数是由中债金融估值中心有限公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中国债券综合全价指数各项指标值的时间序列更加完整，有利于更加深入地研究和分析市场。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，本基金选择市场认同度较高的中国债券综合全价指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。

(2)沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。本基金选择沪深300指数收益率作为股票投资部分的业绩比较基准。

(3)由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照90%、10%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泓德裕康债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年07月15日-2026年06月30日)泓德裕康债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年07月15日-2026年06月30日)



注：1、根据基金合同的约定，本基金建仓期为6个月，截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

2、本基金于2026年3月12日增设D类份额，份额登记日从2026年3月13日起，以上D类份额走势图从2026年3月13日开始。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”或“泓德基金”），成立于2015年3月3日，是经中国证监会证监许可[2015]258号文批准设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币1.43亿元，公司注册地拉萨市。

泓德基金始终以“为客户创造价值”为己任，坚持长期价值投资理念，发挥主动投资管理优势，致力于为广大投资者提供专业、优质、高效的资产管理服务，力争成为受人尊重的资产管理机构。

公司已建立科学规范的公司治理结构，全面有效的风险管理体系，稳定专业的投资研究团队，专业高效的市场服务体系，稳健的运营保障体系。公司已覆盖从公募到专户，从主动权益投资、量化投资到固定收益投资，从低风险到中、高风险等不同产品类型，公募基金产品涵盖股票型、债券型、混合型、货币型等主流基金品种，产品谱系不断完善，满足居民日益多元的财富管理需求。

未来公司将继续秉持投资者利益至上的初心，不断精进，推动公司高质量发展。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
刘星洋	本基金的基金经理	2021-12-31	-	5年	博士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验14年，曾任信银理财有限责任公司投资经理，中信银行股份有限公司资产管理业务中心投资经理，中信银行股份有限公司金融市场部投资经理、分析师。
刘风飞	本基金的基金经理	2025-02-08	-	10年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司固定收益投资部投资经理，北京佑瑞持投资管理有限公司信用研究员。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《泓德基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本报告期内，本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

基本面方面，中国经济整体稳定，但边际走弱，生产强于需求，外需好于内需。一季度，整体的传统耐用品消费景气度一般，房地产投资或仍在底部，但在出口链和高技术产品需求带动下，整体生产情况并不弱。二季度，经济延续生产强需求弱、出口强内需弱的特征结构。二季度的增长的核心驱动力依旧在于出口表现强劲带动生产高增，但政府支出偏弱，国内的地产、基建投资转弱，内需也边际走弱。4月在美伊冲突下原油价格上涨带动相关能化品类价格上涨，国内通缩压力有所缓解。行业方面，得益于原材料、高技术制造业尤其是电子行业的贡献，规模以上工业企业利润自今年以来保持较快增长态势。当然，经济分化的特征非我国独有特征，只是国内叠加房地产筑底期使这种分化更加显著。

在央行对资金面依然呵护下，债券上半年震荡走强。资金利率平稳且在低位。尽管1月的各期限资金利率较上月上升了3-7bps不等，但一季度末的资金利率和波动率显著低于过往几年。尽管面临输入性通胀的压力，但国内资金面及债市定价更多以我为主。在美伊冲突爆发后，央行尽显对资金面呵护的态度，4月的DR001甚至处于政策利率走廊的下沿之下。在基本面无法给出增量信息的情况下，资金面决定了债市的走势，在持续的适度宽松下，10Y国债收益率下行10.03bps，1Y国债收益率下行14.51bps，短端表现略好于长端，信用债好于利率债，利率债的期限利差略走扩，而信用债的期限利差收窄，信用利差收窄。

AI发展趋势提振市场投资科技的情绪，股市在上半年走出了一段极致分化的行情。1月风险情绪较好，但受到监管的降温引导，中小盘好于大盘，其中化工、有色等行业

受到商品期货的带动表现更好。AI主线方面，存储板块最亮眼。2月，市场上涨动能边际减弱。3月，随着中东地缘冲突反复博弈和升级、油价上涨、美联储降息预期推迟等外部因素冲击，市场风险偏好快速下降，主要指数月度均出现下跌。其中，上证50指数单月下跌7.02%，沪深300指数单月下跌5.53%，中证500指数单月下跌12.02%，中证2000指数单月下跌10.70%，受风险偏好影响更大的中小市值股票单月表现弱于大市值股票。随着美国、以色列和伊朗的多方持续博弈，国际油价起伏巨大，市场开始对事件本身脱敏。因为有强劲的业绩增长，以光模块、存储为代表的AI硬件成了“既是进攻，也是防守”的投资标的。在不确定性中，相关AI硬件靠业绩强势领涨。4月，中证500上涨9.61%，中证1000上涨10.00%，科创综指更是上涨了20.50%。5月，股票市场先涨后跌，以AI硬科技为代表的成长风格继续表现优异，科技主导了指数行情，个股层面的表现分化较大，科创50上涨11.47%，而中证红利指数下跌4.88%。6月，尽管几个交易日曾出现风格切换的行情，试图风格再平衡，但最终还是被以半导体为代表的AI硬件所主导。科创506月进一步上涨26.07%，中证红利指数下跌9.97%，微盘股指数下跌11.88%，呈现出极致的分化行情，且波动加大。

分析当下，我国的经济增长的范式发生了一些变化，信贷数据重要，也不重要。重要的是信贷数据与货币政策还是相关，不重要，高质量成长与信贷数据相关性在下降。未来很长一段时间的中国经济新动能毫无疑问是人工智能引领的高端制造业投资。推理成为算力需求的核心驱动，推理环节的Token消耗与并发需求显著抬升，推理侧资本开支将延续高景气。与此同时，资本市场也累积了一定的风险。一是资本市场的预期走在产业发展的前面，若过于超前且预期较高，被各种衍生品、融资盘和趋势资金共同推高后，一旦边际价格函数发生变化，市场会在极短时间内完成原本需要数周甚至数月才能完成的风险释放，这不是慢速的基本面下修，是高速的交易结构坍塌；二是在国外的股市同样存在投资硅基与投资碳基的对比，均是代表硅基需求的个股涨幅更大，代表碳基需求的个股涨幅较小。但A股极致地表现为一个涨幅过大，一个跌幅明显，诚然这里也有对国内基本面的反应，但无论是科技vs红利、科技vs自由现金流、还是科技vs微盘，甚至是部分领涨的科技vs存在基本面改善的某些行业都显示当下的行情过于极致，下半年的A股注定会迎来风格再平衡的一段行情。

投资运作上，裕康保持了灵活的杠杆水平。个券选择上注重安全性和流动性，配置了各期限的利率债、二级资本债和高等级信用债，遵循分散化的策略，在行业、主体和个券上都尽量分散；股票方面在行业上均衡配置，个股选择上秉持长期价值投资的理念，精选个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德裕康债券A基金份额净值为1.4236元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.69%，同期业绩比较基准收益率为1.62%；截至报告期末泓德裕康债券

C基金份额净值为1.3738元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.51%，同期业绩比较基准收益率为1.62%；截至报告期末泓德裕康债券D基金份额净值为1.4240元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.74%，同期业绩比较基准收益率为1.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前展望2026年下半年，我们对大类资产以及行业的观点并未发生变化。债券近期利多因素已被充分定价，但通胀改善的预期、地产高频数据以及风险偏好回升等利空因素或在短期凸显，短期维持震荡的观点。股票方面，一是继续看好AI科技，聚焦硬科技与AI应用落地，但AI科技方面要注意短期高波动的风险；二是看好“反内卷”和顺周期结合的能源、化工、有色、建材等行业。2026年上半年的行情过于极致，下半年的A股注定会迎来风格再平衡的一段行情。裕康作为二级债基，债券部分的久期灵活摆布。股票配置比例中性且风格灵活。我们将继续做好大类资产配置，坚守长期价值投资理念，自下而上在长期更具确定性的赛道里寻找优质标的，摒除短期的扰动，均衡配置，为投资者创造价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值委员会，估值委员会负责指导和监督整个估值流程。估值委员会成员均具有多年证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、基金估值运作、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2026年06月30日，期末可供分配利润为335,053,135.18元，其中：泓德裕康债券A期末可供分配利润为289,198,922.69元（泓德裕康债券A的未分配利润已实现部分为289,198,922.69元，未分配利润未实现部分为205,133,214.49元），泓德裕康债券C期末可供分配利润为10,265,069.10元（泓德裕康债券C的未分配利润已实现部分为10,265,069.10元，未分配利润未实现部分为8,806,184.39元），泓德裕康债券D期末可供分配利润为35,589,143.39元（泓德裕康债券D的未分配利润已实现部分为35,589,143.39元，未分配利润未实现部分为498,375.63元）。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人--泓德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泓德基金管理有限公司编制和披露的本基金2026年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泓德裕康债券型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2026年06月30日	2025年12月31日
资 产:			
货币资金	6.4.7.1	8,195,299.73	202,139.66
结算备付金		7,842,186.45	7,344,496.74
存出保证金		115,766.19	68,684.89
交易性金融资产	6.4.7.2	1,957,957,572.78	1,988,616,261.00
其中：股票投资		356,593,370.73	280,877,093.50
基金投资		-	-
债券投资		1,601,364,202.05	1,707,739,167.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	21,000,989.59	-687.12
应收清算款		10,734,103.13	20,097,252.57
应收股利		-	-
应收申购款		211,666.17	1,242,270.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,006,057,584.04	2,017,570,417.96
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		124,848,959.02	19,999,513.42
应付清算款		10,776,882.38	-
应付赎回款		16,174,441.59	67,461,178.78
应付管理人报酬		920,454.72	1,029,449.18

应付托管费		199,431.85	223,047.33
应付销售服务费		21,776.48	19,039.08
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,106.09	4,470.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	406,040.97	311,067.65
负债合计		153,358,093.10	89,047,765.50
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,303,208,581.25	1,392,696,201.91
未分配利润	6.4.7.8	549,490,909.69	535,826,450.55
净资产合计		1,852,699,490.94	1,928,522,652.46
负债和净资产总计		2,006,057,584.04	2,017,570,417.96

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额总额1,303,208,581.25份，其中A类基金份额总额为1,167,075,529.59份，基金份额净值为1.4236元；C类基金份额总额为51,022,004.15份，基金份额净值为1.3738元；D类基金份额总额为85,111,047.51份，基金份额净值为1.4240元。

6.2 利润表

会计主体：泓德裕康债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		55,344,704.41	11,632,709.28
1.利息收入		114,349.10	89,951.86
其中：存款利息收入	6.4.7.9	31,294.98	9,629.19
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产		83,054.12	80,322.67

收入			
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		40,257,068.55	8,952,912.54
其中：股票投资收益	6.4.7.10	16,900,546.99	2,858,451.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	21,066,835.52	5,546,263.20
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	2,289,686.04	548,197.35
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	14,129,617.12	2,588,861.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	843,669.64	982.96
减：二、营业总支出		7,589,715.86	1,363,683.80
1.管理人报酬		5,682,875.76	878,095.12
2.托管费		1,231,289.75	190,253.90
3.销售服务费		171,112.65	58,904.32
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		369,875.77	130,462.95
其中：卖出回购金融资产 支出		369,875.77	130,462.95
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		6,158.08	754.12
8.其他费用	6.4.7.16	128,403.85	105,213.39
三、利润总额（亏损总额		47,754,988.55	10,269,025.48

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		47,754,988.55	10,269,025.48
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		47,754,988.55	10,269,025.48

6.3 净资产变动表

会计主体：泓德裕康债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,392,696,201.91	535,826,450.55	1,928,522,652.46
二、本期期初净资产	1,392,696,201.91	535,826,450.55	1,928,522,652.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列)	-89,487,620.66	13,664,459.14	-75,823,161.52
（一）、综合收益总额	-	47,754,988.55	47,754,988.55
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列)	-89,487,620.66	-34,090,529.41	-123,578,150.07
其中：1.基金申购款	983,570,688.74	401,352,242.01	1,384,922,930.75
2.基金赎回款	-1,073,058,309.40	-435,442,771.42	-1,508,501,080.82

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,303,208,581.25	549,490,909.69	1,852,699,490.94
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	247,942,310.19	67,143,483.01	315,085,793.20
二、本期期初净资产	247,942,310.19	67,143,483.01	315,085,793.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-680,601.80	10,483,724.13	9,803,122.33
（一）、综合收益总额	-	10,269,025.48	10,269,025.48
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-680,601.80	214,698.65	-465,903.15
其中：1.基金申购款	135,280,115.47	39,410,729.20	174,690,844.67
2.基金赎回款	-135,960,717.27	-39,196,030.55	-175,156,747.82
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	247,261,708.39	77,627,207.14	324,888,915.53

产			
---	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

王德晓	王德晓	王玲
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泓德裕康债券型证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可[2016]796号《关于准予泓德裕康债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由泓德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德裕康债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集207,107,248.47元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2016）第937号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德裕康债券型证券投资基金基金合同》于2016年07月15日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为207,127,733.67份，其中认购资金利息折合20,485.20份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金管理人于 2026年3月12日发布的《泓德基金管理有限公司关于泓德裕康债券型证券投资基金增加D类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，自2026年3月12日起，本基金增加D类基金份额。根据《泓德裕康债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。收取认（申）购费和赎回费，不收取销售服务费的，称为A类基金份额；收取销售服务费和赎回费，不收取认（申）购费的，称为C类基金份额；在投资者申购时，代销机构收取申购费用，但不从本类别基金资产中收取销售服务费的，称为D类基金份额。通过基金管理人直销中心申购本基金D类基金份额的，不收取申购费。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额、C类基金份额和D类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自行选择认/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德裕康债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债

券、资产支持证券、中小企业私募债、债券回购和银行存款、大额存单等固定收益类投资工具，股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种，国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数收益率 $\times 90\%$ +沪深300指数收益率 $\times 10\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》《证券投资基金会计核算业务指引》《泓德裕康债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026年1月1日至2026年6月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税

额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027年12月31日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	8,195,299.73
等于：本金	8,194,885.59
加：应计利息	414.14
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	8,195,299.73

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		336,513,470.84	-	356,593,370.73	20,079,899.89
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	170,793,441.18	588,659.48	170,886,064.15	-496,036.51
	银行间市场	1,413,096,497.49	15,079,137.90	1,430,478,137.90	2,302,502.51
	合计	1,583,889,938.6	15,667,797.38	1,601,364,202.0	1,806,466.00

		7		5	
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,920,403,409.51	15,667,797.38	1,957,957,572.78	21,886,365.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	21,000,989.59	-
合计	21,000,989.59	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,941.87
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	308,887.67
其中：交易所市场	306,509.24
银行间市场	2,378.43
应付利息	-
预提费用	95,211.43
合计	406,040.97

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 泓德裕康债券A

金额单位：人民币元

项目 (泓德裕康债券A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,344,682,192.04	1,344,682,192.04
本期申购	810,248,148.38	810,248,148.38
本期赎回（以“-”号填列）	-987,854,810.83	-987,854,810.83
本期末	1,167,075,529.59	1,167,075,529.59

6.4.7.7.2 泓德裕康债券C

金额单位：人民币元

项目 (泓德裕康债券C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,014,009.87	48,014,009.87
本期申购	67,140,987.86	67,140,987.86
本期赎回（以“-”号填列）	-64,132,993.58	-64,132,993.58
本期末	51,022,004.15	51,022,004.15

6.4.7.7.3 泓德裕康债券D

金额单位：人民币元

项目 (泓德裕康债券D)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	106,181,552.50	106,181,552.50
本期赎回（以“-”号填列）	-21,070,504.99	-21,070,504.99
本期末	85,111,047.51	85,111,047.51

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 泓德裕康债券A

单位：人民币元

项目 (泓德裕康债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	298,214,543.80	221,278,431.79	519,492,975.59
本期期初	298,214,543.80	221,278,431.79	519,492,975.59
本期利润	31,895,772.79	13,667,373.24	45,563,146.03
本期基金份额交易产生的变动数	-40,911,393.90	-29,812,590.54	-70,723,984.44
其中：基金申购款	191,177,750.55	141,786,475.13	332,964,225.68
基金赎回款	-232,089,144.45	-171,599,065.67	-403,688,210.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	289,198,922.69	205,133,214.49	494,332,137.18

6.4.7.8.2 泓德裕康债券C

单位：人民币元

项目 (泓德裕康债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,565,848.34	7,767,626.62	16,333,474.96
本期期初	8,565,848.34	7,767,626.62	16,333,474.96
本期利润	1,792,345.78	-331,990.97	1,460,354.81
本期基金份额交易产生的变动数	-93,125.02	1,370,548.74	1,277,423.72
其中：基金申购款	12,595,085.54	11,864,355.76	24,459,441.30

基金赎回款	-12,688,210.56	-10,493,807.02	-23,182,017.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,265,069.10	8,806,184.39	19,071,253.49

6.4.7.8.3 泓德裕康债券D

单位：人民币元

项目 (泓德裕康债券D)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-62,747.14	794,234.85	731,487.71
本期基金份额交易产生的变动数	35,651,890.53	-295,859.22	35,356,031.31
其中：基金申购款	44,477,805.72	-549,230.69	43,928,575.03
基金赎回款	-8,825,915.19	253,371.47	-8,572,543.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,589,143.39	498,375.63	36,087,519.02

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	13,922.36
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,858.36
其他	5,514.26
合计	31,294.98

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	869,585,542.13
减：卖出股票成本总额	851,506,449.59
减：交易费用	1,178,545.55
买卖股票差价收入	16,900,546.99

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	17,559,278.45
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,507,557.07
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	21,066,835.52

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	465,258,150.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	458,401,350.89
减：应计利息总额	3,340,024.84
减：交易费用	9,217.31
买卖债券差价收入	3,507,557.07

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,289,686.04
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,289,686.04

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	14,129,617.12
——股票投资	12,628,885.80
——债券投资	1,500,731.32
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	14,129,617.12

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	839,320.86
基金转换费收入	4,348.78
合计	843,669.64

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	35,704.06
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	14,592.42
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	128,403.85

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
李娇	基金管理人的自然人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,682,875.76	878,095.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,509,034.21	196,936.07
应支付基金管理人的净管理费	4,173,841.55	681,159.05

注：支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,231,289.75	190,253.90

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.13%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.13%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期			
	2026年01月01日至2026年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	泓德裕康债券A	泓德裕康债券C	泓德裕康债券D	合计
泓德基金	0.00	69.15	0.00	69.15
中国工商 银行	0.00	41,096.56	0.00	41,096.56
合计	0.00	41,165.71	0.00	41,165.71
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间			
	2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	泓德裕康债券A	泓德裕康债券C	合计	
泓德基金	0.00	107.70	107.70	
中国工商 银行	0.00	286.71	286.71	
合计	0.00	394.41	394.41	

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.35%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泓德基金，再由泓德基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额、D类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值×0.35%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

泓德裕康债券C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	1,001.98	0.00%	2,118.84	0.00%

注：本报告期末，自然人股东持有本基金份额占总份额的比例为0.00008%（上年度末：0.0002%）。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	8,195,299.73	13,922.36	368,667.01	3,647.97

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券	证券	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末	备注

代码	名称	认购日	期	受限类型	价格	估值单价	(单位: 张)	成本总额	估值总额	
118072	鼎通转债	2026-06-25	16个交易日	新债未上市	100.00	100.00	110	11,000.00	11,000.34	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票/债券账户，选择网上或者网下一种方式进行新股/新债申购。基金参与申购获配的新股/新债，从新股/新债获配日至新股/新债上市日之间不能自由转让，其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2026年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额95,598,959.02元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
220208	22国开08	2026-07-01	101.42	300,000	30,426,164.38
250211	25国开11	2026-07-01	101.29	200,000	20,257,315.07
260401	26农发01	2026-07-01	100.82	506,000	51,016,583.56
合计				1,006,000	101,700,063.01

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额29,250,000.00元，于2026年7月1日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险

限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他信用良好的境内商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-

A-1以下	-	-
未评级	20,257,315.07	78,485,276.22
合计	20,257,315.07	78,485,276.22

注：1、债券评级取自第三方评级机构（不含中债资信评估有限责任公司）的债项评级。
2、未评级债券包括国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	966,921,473.92	823,851,901.23
AAA以下	19,247,685.71	37,333,756.29
未评级	594,937,727.35	768,068,233.76
合计	1,581,106,886.98	1,629,253,891.28

注：1、债券评级取自第三方评级机构（不含中债资信评估有限责任公司）的债项评级。
2、未评级债券包括国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基

金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在“6.4.12期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限的情况外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产占基金资产净值比例、单一证券占基金资产净值比例及7日可变现资产价值等流动性指标均符合法律法规的要求。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年 06月30	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----------------------	------	------	------	-----	----

日					
资产					
货币资金	8,195,299.73	-	-	-	8,195,299.73
结算备付金	7,842,186.45	-	-	-	7,842,186.45
存出保证金	115,766.19	-	-	-	115,766.19
交易性金融资产	476,399,985.76	974,831,169.66	150,133,046.63	356,593,370.73	1,957,957,572.78
买入返售金融资产	21,000,989.59	-	-	-	21,000,989.59
应收清算款	-	-	-	10,734,103.13	10,734,103.13
应收申购款	-	-	-	211,666.17	211,666.17
资产总计	513,554,227.72	974,831,169.66	150,133,046.63	367,539,140.03	2,006,057,584.04
负债					
卖出回购金融资产款	124,848,959.02	-	-	-	124,848,959.02
应付清算款	-	-	-	10,776,882.38	10,776,882.38
应付赎回款	-	-	-	16,174,441.59	16,174,441.59
应付管理人报酬	-	-	-	920,454.72	920,454.72
应付托管费	-	-	-	199,431.85	199,431.85
应付销售服务费	-	-	-	21,776.48	21,776.48
应交税	-	-	-	10,106.09	10,106.09

费					
其他负债	-	-	-	406,040.97	406,040.97
负债总计	124,848,959.02	-	-	28,509,134.08	153,358,093.10
利率敏感度缺口	388,705,268.70	974,831,169.66	150,133,046.63	339,030,005.95	1,852,699,490.94
上年度末 2025年 12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	202,139.66	-	-	-	202,139.66
结算备付金	7,344,496.74	-	-	-	7,344,496.74
存出保证金	68,684.89	-	-	-	68,684.89
交易性金融资产	579,256,693.74	970,245,424.30	158,237,049.46	280,877,093.50	1,988,616,261.00
买入返售金融资产	-687.12	-	-	-	-687.12
应收清算款	-	-	-	20,097,252.57	20,097,252.57
应收申购款	-	-	-	1,242,270.22	1,242,270.22
资产总计	586,871,327.91	970,245,424.30	158,237,049.46	302,216,616.29	2,017,570,417.96
负债					
卖出回购金融资产款	19,999,513.42	-	-	-	19,999,513.42

应付赎回款	-	-	-	67,461,178.78	67,461,178.78
应付管理人报酬	-	-	-	1,029,449.18	1,029,449.18
应付托管费	-	-	-	223,047.33	223,047.33
应付销售服务费	-	-	-	19,039.08	19,039.08
应交税费	-	-	-	4,470.06	4,470.06
其他负债	-	-	-	311,067.65	311,067.65
负债总计	19,999,513.42	-	-	69,048,252.08	89,047,765.50
利率敏感度缺口	566,871,814.49	970,245,424.30	158,237,049.46	233,168,364.21	1,928,522,652.46

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	市场利率下降25个基点	8,972,541.95	10,585,407.74
	市场利率上升25个基点	-8,806,087.12	-10,366,999.67

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	356,593,370.73	19.25	280,877,093.50	14.56
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	30,102,513.06	1.62	46,249,104.07	2.40
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	386,695,883.79	20.87	327,126,197.57	16.96

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额

		(单位：人民币元)	
		本期末	上年度末
		2026年06月30日	2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	177,533,023.25	-
	业绩比较基准下降5%	-177,533,023.25	-

注：于上年度末，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为16.96%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	386,684,883.45	323,122,474.18
第二层次	1,571,272,689.33	1,665,493,786.82
第三层次	-	-
合计	1,957,957,572.78	1,988,616,261.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估

值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	356,593,370.73	17.78
	其中：股票	356,593,370.73	17.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,601,364,202.05	79.83
	其中：债券	1,601,364,202.05	79.83
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	21,000,989.59	1.05
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,037,486.18	0.80
8	其他各项资产	11,061,535.49	0.55
9	合计	2,006,057,584.04	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,258,704.00	0.07
B	采矿业	8,464,765.00	0.46
C	制造业	262,036,237.97	14.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,083,305.00	0.33
E	建筑业	2,064,022.00	0.11
F	批发和零售业	10,533,803.35	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	6,477,841.00	0.35
H	住宿和餐饮业	88,151.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,309,402.32	1.47
J	金融业	15,310,360.00	0.83
K	房地产业	3,374,273.00	0.18
L	租赁和商务服务业	935,931.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	5,359,759.84	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	4,360,111.25	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	609,039.00	0.03
Q	卫生和社会工作	510,342.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	1,817,323.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	356,593,370.73	19.25

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	3,714	5,925,872.70	0.32
2	002138	顺络电子	72,300	5,285,130.00	0.29

3	002384	东山精密	18,100	4,748,535.00	0.26
4	002371	北方华创	5,200	4,599,712.00	0.25
5	688012	中微公司	9,505	4,453,092.50	0.24
6	002975	博杰股份	26,270	3,730,340.00	0.20
7	300750	宁德时代	8,800	3,458,488.00	0.19
8	300308	中际旭创	2,600	3,302,000.00	0.18
9	300037	新宙邦	34,800	3,231,180.00	0.17
10	688313	仕佳光子	17,196	3,175,241.40	0.17
11	688008	澜起科技	9,966	3,088,463.40	0.17
12	688498	源杰科技	1,567	2,955,362.00	0.16
13	002463	沪电股份	19,300	2,949,040.00	0.16
14	301377	鼎泰高科	5,300	2,919,770.00	0.16
15	002202	金风科技	120,400	2,877,560.00	0.16
16	601138	工业富联	39,200	2,828,280.00	0.15
17	002925	盈趣科技	113,500	2,798,910.00	0.15
18	300014	亿纬锂能	40,800	2,653,224.00	0.14
19	000938	紫光股份	87,300	2,519,478.00	0.14
20	002475	立讯精密	35,400	2,492,160.00	0.13
21	300433	蓝思科技	45,300	2,430,798.00	0.13
22	002938	鹏鼎控股	22,600	2,381,588.00	0.13
23	688041	海光信息	6,409	2,373,252.70	0.13
24	603228	景旺电子	31,500	2,280,915.00	0.12
25	688380	中微半导	31,600	2,082,756.00	0.11
26	601100	恒立液压	18,300	1,968,348.00	0.11
27	002396	星网锐捷	101,210	1,940,195.70	0.10
28	300394	天孚通信	6,300	1,906,884.00	0.10
29	300124	汇川技术	25,000	1,658,250.00	0.09
30	000725	京东方 A	181,900	1,578,892.00	0.09
31	300136	信维通信	12,400	1,478,700.00	0.08
32	603256	宏和科技	5,100	1,353,183.00	0.07
33	301308	江波龙	1,900	1,337,220.00	0.07

34	000703	恒逸石化	98,400	1,335,288.00	0.07
35	688676	金盘科技	15,467	1,309,126.88	0.07
36	002558	巨人网络	45,700	1,259,492.00	0.07
37	600189	泉阳泉	163,900	1,234,167.00	0.07
38	300628	亿联网络	36,400	1,231,048.00	0.07
39	603063	禾望电气	23,100	1,221,759.00	0.07
40	600498	烽火通信	16,324	1,201,446.40	0.06
41	002494	华斯股份	269,800	1,197,912.00	0.06
42	000933	神火股份	55,400	1,174,480.00	0.06
43	300033	同花顺	4,740	1,142,340.00	0.06
44	002497	雅化集团	56,000	1,140,720.00	0.06
45	002812	恩捷股份	16,300	1,090,633.00	0.06
46	601231	环旭电子	33,300	1,078,920.00	0.06
47	600909	华安证券	97,100	1,078,781.00	0.06
48	688503	聚和材料	7,947	1,054,566.90	0.06
49	600048	保利发展	223,900	1,036,657.00	0.06
50	600030	中信证券	34,800	999,804.00	0.05
51	601899	紫金矿业	39,300	988,002.00	0.05
52	688548	广钢气体	18,900	984,690.00	0.05
53	600333	长春燃气	195,800	982,916.00	0.05
54	688019	安集科技	2,882	978,323.72	0.05
55	603986	兆易创新	1,200	978,000.00	0.05
56	000807	云铝股份	44,100	976,374.00	0.05
57	600482	中国动力	29,700	974,160.00	0.05
58	601061	中信金属	89,600	964,992.00	0.05
59	688372	伟测科技	5,179	963,294.00	0.05
60	603979	金诚信	16,000	944,480.00	0.05
61	002428	云南锗业	7,800	937,404.00	0.05
62	300483	首华燃气	53,000	931,740.00	0.05
63	300823	建科智能	63,600	927,288.00	0.05
64	600801	华新建材	58,700	915,720.00	0.05

65	601211	国泰海通	50,300	915,460.00	0.05
66	601688	华泰证券	44,300	913,466.00	0.05
67	300003	乐普医疗	76,300	904,155.00	0.05
68	301607	富特科技	17,220	899,745.00	0.05
69	002493	荣盛石化	83,300	895,475.00	0.05
70	300548	长芯博创	3,200	889,600.00	0.05
71	301095	广立微	7,500	885,375.00	0.05
72	300661	圣邦股份	6,100	875,228.00	0.05
73	002028	思源电气	5,000	865,000.00	0.05
74	688410	山外山	59,956	860,968.16	0.05
75	605366	宏柏新材	65,960	859,458.80	0.05
76	002064	华峰化学	89,600	850,304.00	0.05
77	300502	新易盛	1,400	849,800.00	0.05
78	688307	中润光学	10,500	839,475.00	0.05
79	002415	海康威视	24,500	837,900.00	0.05
80	601600	中国铝业	101,700	835,974.00	0.05
81	301393	昊帆生物	12,900	835,533.00	0.05
82	688600	皖仪科技	24,783	824,778.24	0.04
83	601360	三六零	94,900	824,681.00	0.04
84	300408	三环集团	4,900	817,810.00	0.04
85	688257	新锐股份	8,000	815,200.00	0.04
86	688536	思瑞浦	2,239	815,197.51	0.04
87	301280	珠城科技	16,100	814,177.00	0.04
88	600595	中孚实业	144,800	813,776.00	0.04
89	688002	睿创微纳	5,253	812,586.57	0.04
90	002284	亚太股份	85,600	812,344.00	0.04
91	002008	大族激光	5,400	810,594.00	0.04
92	300031	宝通科技	28,200	805,674.00	0.04
93	603061	金海通	1,600	803,552.00	0.04
94	603071	物产环能	72,600	802,956.00	0.04
95	605567	春雪食品	100,000	799,000.00	0.04

96	688059	华锐精密	4,000	798,840.00	0.04
97	001339	智微智能	7,800	797,784.00	0.04
98	688156	路德科技	26,369	797,662.25	0.04
99	002624	完美世界	64,100	796,122.00	0.04
100	002817	黄山胶囊	135,700	795,202.00	0.04
101	300567	精测电子	2,500	794,000.00	0.04
102	688518	联赢激光	25,600	791,040.00	0.04
103	688103	国力电子	10,608	789,341.28	0.04
104	301122	采纳股份	26,800	788,188.00	0.04
105	300438	鹏辉能源	9,500	787,075.00	0.04
106	301099	雅创电子	8,200	783,100.00	0.04
107	688378	奥来德	12,600	781,200.00	0.04
108	002107	沃华医药	136,900	778,961.00	0.04
109	688678	福立旺	32,183	777,863.11	0.04
110	301031	中熔电气	6,500	776,425.00	0.04
111	002120	韵达股份	122,000	775,920.00	0.04
112	688110	东芯股份	3,800	774,060.00	0.04
113	600969	郴电国际	101,300	772,919.00	0.04
114	301487	盟固利	40,300	771,745.00	0.04
115	600033	福建高速	239,200	770,224.00	0.04
116	688630	芯碁微装	1,400	769,146.00	0.04
117	688766	普冉股份	1,000	766,600.00	0.04
118	603816	顾家家居	34,100	762,476.00	0.04
119	300390	天华新能	8,100	757,431.00	0.04
120	601816	京沪高铁	166,700	755,151.00	0.04
121	688293	奥浦迈	18,100	754,589.00	0.04
122	001309	德明利	800	754,320.00	0.04
123	002517	恺英网络	46,300	752,375.00	0.04
124	600989	宝丰能源	36,700	746,111.00	0.04
125	688653	康希通信	42,884	745,323.92	0.04
126	688717	艾罗能源	9,023	745,029.11	0.04

127	301087	可孚医疗	15,600	743,340.00	0.04
128	605117	德业股份	7,000	743,260.00	0.04
129	301055	张小泉	17,500	743,225.00	0.04
130	301281	科源制药	15,000	739,500.00	0.04
131	600346	恒力石化	41,700	738,507.00	0.04
132	603010	万盛股份	40,600	735,672.00	0.04
133	001337	四川黄金	20,000	733,200.00	0.04
134	688428	诺诚健华	25,741	732,846.27	0.04
135	002916	深南电路	1,600	732,640.00	0.04
136	688182	灿勤科技	17,000	732,190.00	0.04
137	600900	长江电力	27,600	730,572.00	0.04
138	301039	中集车辆	103,600	730,380.00	0.04
139	301382	蜂助手	15,800	726,800.00	0.04
140	600295	鄂尔多斯	67,700	725,744.00	0.04
141	301189	奥尼电子	12,300	724,839.00	0.04
142	002956	西麦食品	34,900	724,524.00	0.04
143	300277	汽轮科技	48,100	723,424.00	0.04
144	300475	香农芯创	2,400	720,000.00	0.04
145	002850	科达利	3,800	719,340.00	0.04
146	300604	长川科技	2,100	716,982.00	0.04
147	001314	亿道信息	11,600	716,880.00	0.04
148	688388	嘉元科技	16,240	714,560.00	0.04
149	002821	凯莱英	4,400	712,800.00	0.04
150	605289	罗曼股份	4,900	710,500.00	0.04
151	688309	恒誉环保	11,652	709,373.76	0.04
152	300592	华凯易佰	39,800	704,460.00	0.04
153	688235	百济神州	2,766	704,251.26	0.04
154	688683	莱尔科技	18,485	700,951.20	0.04
155	001387	雪祺电气	54,800	699,796.00	0.04
156	301086	鸿富瀚	3,340	698,995.20	0.04
157	301096	百诚医药	12,200	697,718.00	0.04

158	301321	翰博高新	15,800	697,570.00	0.04
159	002266	浙富控股	137,600	696,256.00	0.04
160	601002	晋亿实业	161,100	695,952.00	0.04
161	301536	星宸科技	5,400	695,034.00	0.04
162	300550	和仁科技	52,100	694,493.00	0.04
163	688239	航宇科技	11,600	694,028.00	0.04
164	000990	诚志股份	84,700	692,846.00	0.04
165	301097	天益医疗	19,400	692,580.00	0.04
166	002532	天山铝业	64,500	692,085.00	0.04
167	688416	恒烁股份	4,940	691,600.00	0.04
168	600188	兖矿能源	38,700	687,699.00	0.04
169	300590	移为通信	47,900	687,365.00	0.04
170	600426	华鲁恒升	28,600	684,112.00	0.04
171	300331	苏大维格	9,600	682,656.00	0.04
172	600276	恒瑞医药	13,100	681,724.00	0.04
173	600549	厦门钨业	8,000	681,600.00	0.04
174	300681	英搏尔	23,800	681,156.00	0.04
175	300857	协创数据	2,000	679,800.00	0.04
176	688700	东威科技	7,600	679,440.00	0.04
177	688275	万润新能	5,306	676,780.30	0.04
178	688266	泽璟制药	5,800	676,628.00	0.04
179	688609	九联科技	61,398	675,991.98	0.04
180	300953	震裕科技	5,040	673,848.00	0.04
181	688301	奕瑞科技	5,431	673,444.00	0.04
182	300756	金马游乐	20,360	672,898.00	0.04
183	600886	国投电力	50,500	672,155.00	0.04
184	688368	晶丰明源	3,100	671,212.00	0.04
185	600148	长春一东	46,200	670,362.00	0.04
186	002379	宏桥控股	45,300	669,081.00	0.04
187	300270	中威电子	51,300	667,413.00	0.04
188	003031	中瓷电子	3,700	667,110.00	0.04

189	300776	帝尔激光	3,100	666,376.00	0.04
190	601872	招商轮船	37,900	665,903.00	0.04
191	688218	江苏北人	12,100	665,016.00	0.04
192	300694	蠡湖股份	69,200	664,320.00	0.04
193	600768	宁波富邦	44,300	663,614.00	0.04
194	601126	四方股份	10,500	663,600.00	0.04
195	600176	中国巨石	9,100	663,208.00	0.04
196	300022	吉峰科技	85,000	660,450.00	0.04
197	688090	瑞松科技	6,200	659,990.00	0.04
198	300005	探路者	29,100	657,660.00	0.04
199	002460	赣锋锂业	10,000	654,000.00	0.04
200	002414	高德红外	49,200	652,392.00	0.04
201	688035	德邦科技	7,000	642,600.00	0.03
202	002838	道恩股份	20,900	639,958.00	0.03
203	001212	中旗新材	13,500	639,630.00	0.03
204	688668	鼎通科技	1,700	634,610.00	0.03
205	002772	众兴菌业	55,800	633,888.00	0.03
206	301203	国泰环保	14,900	629,525.00	0.03
207	600778	友好集团	128,000	625,920.00	0.03
208	688321	微芯生物	23,747	625,258.51	0.03
209	301389	隆扬电子	7,200	624,888.00	0.03
210	002918	蒙娜丽莎	62,100	624,105.00	0.03
211	688100	威胜信息	20,334	622,017.06	0.03
212	300700	岱勒新材	29,200	621,376.00	0.03
213	300909	汇创达	10,600	617,132.00	0.03
214	002919	名臣健康	32,300	613,377.00	0.03
215	000790	华神科技	174,700	609,703.00	0.03
216	001286	陕西能源	59,900	607,386.00	0.03
217	688021	奥福科技	31,100	602,096.00	0.03
218	300201	海伦哲	28,300	596,281.00	0.03
219	600292	电投水电	49,500	595,980.00	0.03

220	002738	中矿资源	10,100	595,799.00	0.03
221	603588	高能环境	31,000	595,200.00	0.03
222	688255	凯尔达	21,396	594,808.80	0.03
223	603279	景津装备	49,500	594,000.00	0.03
224	600312	平高电气	33,400	589,844.00	0.03
225	600419	天润乳业	77,900	589,703.00	0.03
226	600966	博汇纸业	123,300	589,374.00	0.03
227	688067	爱威科技	29,222	588,823.30	0.03
228	688267	中触媒	29,661	584,321.70	0.03
229	300853	申昊科技	18,800	580,732.00	0.03
230	301193	家联科技	31,000	574,740.00	0.03
231	300432	富临精工	28,600	574,574.00	0.03
232	002911	佛燃能源	60,500	574,145.00	0.03
233	603444	吉比特	1,600	573,472.00	0.03
234	002440	闰土股份	55,900	572,975.00	0.03
235	600029	南方航空	110,500	572,390.00	0.03
236	600395	盘江股份	125,400	571,824.00	0.03
237	300969	恒帅股份	6,080	570,060.80	0.03
238	001311	多利科技	35,160	567,130.80	0.03
239	605001	威奥股份	103,700	565,165.00	0.03
240	300635	中达安	46,400	564,688.00	0.03
241	002142	宁波银行	19,000	564,110.00	0.03
242	301136	招标股份	51,000	559,980.00	0.03
243	600026	中远海能	31,200	559,728.00	0.03
244	688111	金山办公	2,626	559,469.30	0.03
245	001979	招商蛇口	85,900	552,337.00	0.03
246	300120	经纬辉开	48,200	546,106.00	0.03
247	002661	克明食品	78,000	540,540.00	0.03
248	603901	永创智能	49,641	539,597.67	0.03
249	000338	潍柴动力	19,800	539,550.00	0.03
250	600287	苏豪时尚	122,200	538,902.00	0.03

251	603516	淳中科技	4,000	538,440.00	0.03
252	600051	宁波联合	95,600	538,228.00	0.03
253	300919	中伟新材	12,300	538,125.00	0.03
254	605151	西上海	30,300	533,583.00	0.03
255	600233	圆通速递	33,600	529,200.00	0.03
256	300050	世纪鼎利	89,200	528,064.00	0.03
257	300407	凯发电气	48,800	527,040.00	0.03
258	603132	金徽股份	33,700	525,046.00	0.03
259	600883	博闻科技	74,800	523,600.00	0.03
260	000548	湖南投资	127,500	521,475.00	0.03
261	000975	山金国际	30,600	520,200.00	0.03
262	002452	长高电气	40,500	517,185.00	0.03
263	300696	爱乐达	19,800	515,394.00	0.03
264	301269	华大九天	4,300	513,506.00	0.03
265	601139	深圳燃气	90,600	512,796.00	0.03
266	688171	纬德信息	11,661	512,617.56	0.03
267	600218	全柴动力	70,900	511,898.00	0.03
268	301360	荣旗科技	7,430	508,880.70	0.03
269	300800	力合科技	54,900	507,825.00	0.03
270	002188	中天服务	103,100	505,190.00	0.03
271	688772	珠海冠宇	25,605	502,626.15	0.03
272	000425	徐工机械	61,800	499,962.00	0.03
273	600105	永鼎股份	7,400	499,352.00	0.03
274	002541	鸿路钢构	28,800	498,816.00	0.03
275	603338	浙江鼎力	11,700	497,250.00	0.03
276	688016	心脉医疗	5,592	495,674.88	0.03
277	600115	中国东航	130,000	495,300.00	0.03
278	688525	佰维存储	1,000	494,730.00	0.03
279	603569	长久物流	93,200	493,960.00	0.03
280	300629	新劲刚	23,000	493,580.00	0.03
281	300977	深圳瑞捷	31,800	490,356.00	0.03

282	300512	中亚股份	71,700	488,994.00	0.03
283	600638	新黄浦	111,700	488,129.00	0.03
284	002373	千方科技	67,600	485,368.00	0.03
285	601898	中煤能源	39,800	484,764.00	0.03
286	601121	宝地矿业	85,700	483,348.00	0.03
287	603326	我乐家居	78,300	482,328.00	0.03
288	600099	林海股份	60,400	481,992.00	0.03
289	000027	深圳能源	77,400	479,880.00	0.03
290	300222	科大智能	34,600	479,210.00	0.03
291	300666	江丰电子	1,300	479,180.00	0.03
292	688778	厦钨新能	8,765	476,816.00	0.03
293	688248	南网科技	6,838	473,052.84	0.03
294	600885	宏发股份	13,700	472,513.00	0.03
295	688636	智明达	13,028	472,004.44	0.03
296	002016	世荣兆业	116,100	464,400.00	0.03
297	300645	正元智慧	38,800	456,676.00	0.02
298	301156	美农生物	41,810	454,474.70	0.02
299	600031	三一重工	26,100	451,008.00	0.02
300	600104	上汽集团	45,900	447,984.00	0.02
301	002271	东方雨虹	37,600	446,312.00	0.02
302	301150	中一科技	7,000	441,770.00	0.02
303	600235	民丰特纸	88,300	438,851.00	0.02
304	603057	紫燕食品	19,500	434,850.00	0.02
305	300535	达威股份	31,800	433,434.00	0.02
306	600858	银座股份	98,200	433,062.00	0.02
307	603345	安井食品	5,400	433,026.00	0.02
308	601179	中国西电	28,500	425,220.00	0.02
309	600489	中金黄金	23,500	424,175.00	0.02
310	002488	金固股份	47,100	419,661.00	0.02
311	605196	华通线缆	16,000	417,600.00	0.02
312	002666	德联集团	105,700	417,515.00	0.02

313	301283	聚胶股份	16,930	414,446.40	0.02
314	603799	华友钴业	8,500	410,210.00	0.02
315	605122	四方新材	38,000	409,640.00	0.02
316	603501	豪威集团	4,300	407,855.00	0.02
317	002609	捷顺科技	53,500	407,670.00	0.02
318	688091	上海谊众	10,116	406,663.20	0.02
319	002706	良信股份	37,200	405,852.00	0.02
320	603259	药明康德	3,200	398,432.00	0.02
321	600356	恒丰纸业	53,700	397,917.00	0.02
322	300491	通合科技	10,400	397,176.00	0.02
323	603050	科林电气	20,200	395,112.00	0.02
324	002272	川润股份	15,900	390,027.00	0.02
325	601799	星宇股份	4,300	389,666.00	0.02
326	000682	东方电子	30,600	386,478.00	0.02
327	688322	奥比中光	2,933	382,903.15	0.02
328	601728	中国电信	73,200	379,908.00	0.02
329	688681	科汇股份	27,126	379,221.48	0.02
330	688507	索辰科技	1,400	377,552.00	0.02
331	002803	吉宏股份	14,400	372,096.00	0.02
332	300458	全志科技	9,360	369,345.60	0.02
333	603096	新经典	27,600	369,288.00	0.02
334	600150	中国船舶	10,900	368,311.00	0.02
335	600406	国电南瑞	16,100	367,885.00	0.02
336	688659	元琛科技	35,132	366,778.08	0.02
337	601801	皖新传媒	74,300	366,299.00	0.02
338	603666	亿嘉和	13,200	364,584.00	0.02
339	603083	剑桥科技	1,400	356,818.00	0.02
340	000301	东方盛虹	31,100	356,095.00	0.02
341	688113	联测科技	10,100	354,510.00	0.02
342	688475	萤石网络	12,959	354,428.65	0.02
343	600623	华谊集团	43,800	353,466.00	0.02

344	601222	林洋能源	66,200	352,184.00	0.02
345	300190	维尔利	84,600	351,090.00	0.02
346	002262	恩华药业	18,700	350,625.00	0.02
347	601601	中国太保	12,200	347,944.00	0.02
348	000893	亚钾国际	8,500	347,565.00	0.02
349	603970	中农立华	35,500	341,865.00	0.02
350	002270	华明装备	18,100	341,185.00	0.02
351	301503	智迪科技	12,400	341,124.00	0.02
352	603150	万朗磁塑	4,800	339,840.00	0.02
353	688087	英科再生	9,916	331,392.72	0.02
354	002483	润邦股份	66,800	329,992.00	0.02
355	000951	中国重汽	16,900	329,719.00	0.02
356	600335	国机汽车	70,100	328,068.00	0.02
357	002244	滨江集团	43,100	327,560.00	0.02
358	601869	长飞光纤	600	327,540.00	0.02
359	300358	楚天科技	40,900	327,200.00	0.02
360	605577	龙版传媒	37,000	325,970.00	0.02
361	001313	粤海饲料	45,900	325,431.00	0.02
362	600502	安徽建工	74,600	324,510.00	0.02
363	000032	深桑达 A	13,000	324,350.00	0.02
364	301290	东星医疗	11,900	324,275.00	0.02
365	002027	分众传媒	66,800	323,312.00	0.02
366	002593	日上集团	80,900	322,791.00	0.02
367	301239	普瑞眼科	10,600	322,770.00	0.02
368	002398	垒知集团	86,000	322,500.00	0.02
369	002648	卫星化学	13,700	321,813.00	0.02
370	002873	新天药业	43,900	321,348.00	0.02
371	688187	时代电气	4,679	321,260.14	0.02
372	600551	时代出版	48,300	321,195.00	0.02
373	002659	凯文教育	85,800	320,892.00	0.02
374	603908	牧高笛	19,000	320,720.00	0.02

375	002441	众业达	41,100	320,580.00	0.02
376	002381	双箭股份	61,700	319,606.00	0.02
377	600535	天士力	24,100	318,843.00	0.02
378	600854	春兰股份	78,300	318,681.00	0.02
379	301167	建研设计	25,700	318,423.00	0.02
380	603066	音飞储存	32,600	318,176.00	0.02
381	300030	阳普医疗	54,700	317,807.00	0.02
382	600580	卧龙电驱	9,600	317,760.00	0.02
383	003016	欣贺股份	51,800	317,534.00	0.02
384	688468	科美诊断	55,800	317,502.00	0.02
385	003816	中国广核	81,000	316,710.00	0.02
386	000553	安道麦A	59,100	316,185.00	0.02
387	300511	雪榕生物	62,800	315,884.00	0.02
388	002154	报喜鸟	88,700	315,772.00	0.02
389	688200	华峰测控	600	315,060.00	0.02
390	002790	瑞尔特	59,200	314,944.00	0.02
391	600309	万华化学	4,600	314,686.00	0.02
392	600929	雪天盐业	69,300	314,622.00	0.02
393	600550	保变电气	26,800	314,364.00	0.02
394	600833	第一医药	34,800	313,896.00	0.02
395	603861	白云电器	24,300	313,713.00	0.02
396	603808	歌力思	41,400	313,398.00	0.02
397	688213	思特威	2,924	313,072.68	0.02
398	001336	楚环科技	14,200	312,684.00	0.02
399	002462	嘉事堂	29,100	312,243.00	0.02
400	600546	山煤国际	28,500	311,505.00	0.02
401	600496	精工钢构	100,400	311,240.00	0.02
402	000708	中信特钢	24,500	309,190.00	0.02
403	300970	华绿生物	16,900	308,932.00	0.02
404	002454	松芝股份	64,300	307,354.00	0.02
405	002671	龙泉股份	82,400	305,704.00	0.02

406	600230	沧州大化	23,300	303,366.00	0.02
407	603893	瑞芯微	1,600	301,376.00	0.02
408	603385	惠达卫浴	61,700	301,096.00	0.02
409	603233	大参林	19,845	298,270.35	0.02
410	000400	许继电气	13,700	297,290.00	0.02
411	603187	海容冷链	25,500	292,995.00	0.02
412	600517	国网英大	61,900	289,692.00	0.02
413	600661	昂立教育	41,700	288,147.00	0.02
414	301060	兰卫医学	34,300	280,231.00	0.02
415	300360	炬华科技	23,800	279,650.00	0.02
416	603997	继峰股份	23,600	279,188.00	0.02
417	688169	石头科技	2,870	272,563.90	0.01
418	688343	云天励飞	3,313	270,539.58	0.01
419	603176	汇通集团	63,000	269,640.00	0.01
420	688578	艾力斯	2,453	267,867.60	0.01
421	688018	乐鑫科技	2,080	266,073.60	0.01
422	002712	思美传媒	64,100	266,015.00	0.01
423	002616	长青集团	59,200	264,624.00	0.01
424	603615	茶花股份	16,300	263,245.00	0.01
425	300418	昆仑万维	6,500	262,340.00	0.01
426	688615	合合信息	2,318	262,165.80	0.01
427	300972	万辰集团	1,500	260,115.00	0.01
428	000636	风华高科	3,600	260,064.00	0.01
429	603530	神马电力	5,100	259,590.00	0.01
430	600999	招商证券	12,300	259,530.00	0.01
431	301631	壹连科技	3,600	258,696.00	0.01
432	688225	亚信安全	20,826	258,658.92	0.01
433	300364	中文在线	10,900	257,131.00	0.01
434	002799	环球印务	42,500	257,125.00	0.01
435	600741	华域汽车	16,400	254,528.00	0.01
436	002606	大连电瓷	18,900	253,449.00	0.01

437	601998	中信银行	36,200	250,866.00	0.01
438	601066	中信建投	8,600	250,002.00	0.01
439	601699	潞安环能	17,500	249,900.00	0.01
440	000039	中集集团	30,800	249,788.00	0.01
441	603041	美思德	24,000	248,880.00	0.01
442	002763	汇洁股份	36,500	247,835.00	0.01
443	300496	中科创达	4,000	247,160.00	0.01
444	603556	海兴电力	11,200	246,400.00	0.01
445	601058	赛轮轮胎	21,300	245,589.00	0.01
446	300422	博世科	58,200	245,022.00	0.01
447	002412	汉森制药	44,500	244,750.00	0.01
448	603909	建发合诚	28,500	243,105.00	0.01
449	688049	炬芯科技	5,182	243,087.62	0.01
450	603085	天成自控	21,800	236,966.00	0.01
451	002339	积成电子	33,700	233,541.00	0.01
452	000783	长江证券	23,800	232,050.00	0.01
453	002439	启明星辰	18,300	231,495.00	0.01
454	605266	健之佳	15,800	231,312.00	0.01
455	300575	中旗股份	47,000	231,240.00	0.01
456	301178	天亿马	4,640	230,840.00	0.01
457	301236	软通动力	5,400	229,230.00	0.01
458	688327	云从科技	18,017	224,491.82	0.01
459	600906	财达证券	30,000	223,800.00	0.01
460	000421	南京公用	45,100	223,696.00	0.01
461	601995	中金公司	6,100	220,515.00	0.01
462	601208	东材科技	3,100	219,449.00	0.01
463	688329	艾隆科技	10,800	218,268.00	0.01
464	002230	科大讯飞	5,300	216,452.00	0.01
465	300610	晨化股份	22,100	215,475.00	0.01
466	000776	广发证券	9,200	215,280.00	0.01
467	300838	浙江力诺	16,100	214,935.00	0.01

468	002566	益盛药业	35,500	214,420.00	0.01
469	002261	拓维信息	7,600	212,876.00	0.01
470	688183	生益电子	1,583	209,589.20	0.01
471	601377	兴业证券	34,300	207,172.00	0.01
472	688758	赛分科技	9,281	204,274.81	0.01
473	601198	东兴证券	15,000	203,850.00	0.01
474	002065	东华软件	28,100	200,634.00	0.01
475	301108	洁雅股份	8,500	200,515.00	0.01
476	603836	海程邦达	25,180	198,922.00	0.01
477	300253	卫宁健康	29,500	198,535.00	0.01
478	300459	汤姆猫	57,900	196,281.00	0.01
479	000419	通程控股	43,500	196,185.00	0.01
480	603093	南华期货	10,800	196,020.00	0.01
481	301526	国际复材	4,200	196,014.00	0.01
482	600109	国金证券	22,300	195,794.00	0.01
483	601108	财通证券	22,500	194,625.00	0.01
484	002797	第一创业	29,600	194,472.00	0.01
485	300339	润和软件	5,000	192,550.00	0.01
486	000686	东北证券	22,900	192,360.00	0.01
487	601696	中银证券	15,200	192,280.00	0.01
488	601886	江河集团	23,900	191,917.00	0.01
489	601059	信达证券	11,800	191,042.00	0.01
490	688318	财富趋势	2,675	190,754.25	0.01
491	688088	虹软科技	5,360	190,548.00	0.01
492	002111	威海广泰	21,100	189,900.00	0.01
493	600955	维远股份	12,900	189,888.00	0.01
494	600941	中国移动	2,200	189,486.00	0.01
495	601375	中原证券	47,300	188,727.00	0.01
496	002152	广电运通	20,100	188,538.00	0.01
497	601456	国联民生	21,200	187,408.00	0.01
498	601901	方正证券	26,000	187,200.00	0.01

499	002758	浙农股份	23,500	185,650.00	0.01
500	300059	东方财富	9,100	185,458.00	0.01
501	300229	拓尔思	13,400	185,188.00	0.01
502	688608	恒玄科技	1,107	185,079.33	0.01
503	000728	国元证券	24,700	185,003.00	0.01
504	688466	金科环境	14,400	184,752.00	0.01
505	002926	华西证券	22,500	183,825.00	0.01
506	601878	浙商证券	19,300	183,350.00	0.01
507	600369	西南证券	45,400	182,508.00	0.01
508	600588	用友网络	19,800	181,764.00	0.01
509	688237	超卓航科	3,400	181,628.00	0.01
510	600570	恒生电子	8,500	180,115.00	0.01
511	000166	申万宏源	40,900	179,960.00	0.01
512	002920	德赛西威	2,200	179,300.00	0.01
513	688208	道通科技	7,104	178,949.76	0.01
514	300002	神州泰岳	22,900	178,849.00	0.01
515	600061	国投资本	27,300	178,815.00	0.01
516	000876	新希望	28,500	178,695.00	0.01
517	688310	迈得医疗	11,616	178,537.92	0.01
518	000750	国海证券	48,300	177,744.00	0.01
519	300251	光线传媒	16,000	177,440.00	0.01
520	601788	光大证券	12,200	176,046.00	0.01
521	002500	山西证券	34,100	175,956.00	0.01
522	002939	长城证券	21,000	175,140.00	0.01
523	601236	红塔证券	25,600	174,592.00	0.01
524	601555	东吴证券	22,000	174,240.00	0.01
525	600137	浪莎股份	10,700	173,661.00	0.01
526	601881	中国银河	13,800	173,466.00	0.01
527	603927	中科软	13,600	172,856.00	0.01
528	300638	广和通	9,300	172,143.00	0.01
529	600918	中泰证券	32,200	171,304.00	0.01

530	601990	南京证券	26,000	170,820.00	0.01
531	002410	广联达	20,700	168,912.00	0.01
532	300674	宇信科技	11,200	168,560.00	0.01
533	688251	井松智能	6,558	168,081.54	0.01
534	600155	华创云信	30,400	167,808.00	0.01
535	301358	湖南裕能	2,200	166,914.00	0.01
536	002736	国信证券	16,700	166,833.00	0.01
537	002673	西部证券	25,700	166,793.00	0.01
538	301588	美新科技	3,800	166,288.00	0.01
539	600621	华鑫股份	12,800	165,376.00	0.01
540	000810	创维数字	12,400	164,300.00	0.01
541	600864	哈投股份	31,600	164,004.00	0.01
542	601099	太平洋	48,600	163,782.00	0.01
543	300787	海能实业	17,800	162,336.00	0.01
544	600446	金证股份	16,100	161,966.00	0.01
545	002961	瑞达期货	8,200	160,556.00	0.01
546	002945	华林证券	11,900	159,817.00	0.01
547	688616	西力科技	15,796	159,539.60	0.01
548	002484	江海股份	1,500	157,500.00	0.01
549	600927	永安期货	12,600	156,870.00	0.01
550	601225	陕西煤业	7,700	156,695.00	0.01
551	601136	首创证券	11,200	156,240.00	0.01
552	300015	爱尔眼科	18,900	156,114.00	0.01
553	000712	锦龙股份	17,500	155,050.00	0.01
554	000997	新大陆	9,400	153,220.00	0.01
555	600938	中国海油	5,600	152,040.00	0.01
556	300620	光库科技	400	151,280.00	0.01
557	002670	国盛证券	12,800	140,800.00	0.01
558	605208	永茂泰	8,800	140,360.00	0.01
559	601088	中国神华	3,500	136,640.00	0.01
560	600095	湘财股份	18,100	136,293.00	0.01

561	300647	超频三	22,800	135,660.00	0.01
562	601918	新集能源	15,700	134,863.00	0.01
563	688188	柏楚电子	1,228	131,027.60	0.01
564	601339	百隆东方	19,300	130,661.00	0.01
565	601567	三星电气	8,700	129,978.00	0.01
566	002849	威星智能	7,000	118,440.00	0.01
567	301510	固高科技	3,700	118,141.00	0.01
568	300672	国科微	400	118,000.00	0.01
569	001218	丽臣实业	5,300	116,918.00	0.01
570	600874	创业环保	20,900	112,024.00	0.01
571	600704	物产中大	23,600	111,392.00	0.01
572	300740	水羊股份	5,700	104,937.00	0.01
573	002826	易明医药	6,900	103,707.00	0.01
574	300122	智飞生物	8,700	101,703.00	0.01
575	301215	中汽股份	19,300	100,167.00	0.01
576	600098	广州发展	16,600	98,106.00	0.01
577	603703	盛洋科技	8,800	97,680.00	0.01
578	600754	锦江酒店	4,900	88,151.00	0.00
579	688375	国博电子	800	83,440.00	0.00
580	600057	厦门象屿	14,300	77,506.00	0.00
581	300073	当升科技	1,600	76,864.00	0.00
582	300743	天地数码	4,900	71,491.00	0.00
583	300058	蓝色光标	5,100	70,176.00	0.00
584	601939	建设银行	7,100	68,373.00	0.00
585	002727	一心堂	6,800	65,212.00	0.00
586	600738	丽尚国潮	16,300	58,680.00	0.00
587	301511	德福科技	400	57,540.00	0.00
588	000001	平安银行	5,400	54,270.00	0.00
589	605376	博迁新材	200	54,260.00	0.00
590	002004	华邦健康	11,000	43,230.00	0.00
591	603126	中材节能	6,200	39,060.00	0.00

592	000333	美的集团	500	37,765.00	0.00
593	603214	爱婴室	3,000	36,330.00	0.00
594	301103	何氏眼科	2,100	31,458.00	0.00
595	601857	中国石油	3,300	28,644.00	0.00
596	000915	华特达因	1,000	28,310.00	0.00
597	600697	欧亚集团	2,600	25,272.00	0.00
598	600282	南钢股份	5,500	25,245.00	0.00
599	601628	中国人寿	700	24,745.00	0.00
600	600386	北巴传媒	7,800	24,336.00	0.00
601	000900	现代投资	5,900	20,414.00	0.00
602	601328	交通银行	3,100	19,933.00	0.00
603	000651	格力电器	500	18,750.00	0.00
604	301065	本立科技	800	14,120.00	0.00
605	600019	宝钢股份	2,200	11,946.00	0.00
606	600067	冠城新材	2,800	8,120.00	0.00
607	600351	亚宝药业	1,300	7,475.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000900	现代投资	3,230,151.00	0.17
2	600801	华新建材	3,106,868.00	0.16
3	600938	中国海油	3,073,899.00	0.16
4	601211	国泰海通	3,055,922.00	0.16
5	300750	宁德时代	2,888,618.00	0.15
6	600900	长江电力	2,803,236.00	0.15
7	600380	健康元	2,726,245.00	0.14
8	601088	中国神华	2,718,877.00	0.14

9	002558	巨人网络	2,718,019.00	0.14
10	000933	神火股份	2,677,214.00	0.14
11	002142	宁波银行	2,647,344.00	0.14
12	601801	皖新传媒	2,632,875.00	0.14
13	603816	顾家家居	2,597,102.00	0.13
14	603889	新澳股份	2,533,686.00	0.13
15	301376	致欧科技	2,465,528.00	0.13
16	002415	海康威视	2,458,156.00	0.13
17	600941	中国移动	2,387,002.00	0.12
18	688015	交控科技	2,383,542.33	0.12
19	601997	贵阳银行	2,375,093.00	0.12
20	002483	润邦股份	2,368,700.20	0.12

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000900	现代投资	3,621,715.00	0.19
2	601088	中国神华	3,238,075.00	0.17
3	688267	中触媒	3,098,825.37	0.16
4	601801	皖新传媒	3,007,300.00	0.16
5	601225	陕西煤业	2,882,594.00	0.15
6	600938	中国海油	2,769,051.00	0.14
7	600380	健康元	2,715,305.00	0.14
8	603889	新澳股份	2,690,191.00	0.14
9	600031	三一重工	2,670,046.00	0.14
10	600941	中国移动	2,587,594.00	0.13
11	301376	致欧科技	2,512,020.00	0.13
12	002624	完美世界	2,500,058.00	0.13
13	600011	华能国际	2,498,873.00	0.13

14	601872	招商轮船	2,470,516.80	0.13
15	601857	中国石油	2,453,895.00	0.13
16	000333	美的集团	2,450,050.00	0.13
17	601211	国泰海通	2,443,091.00	0.13
18	601997	贵阳银行	2,412,321.00	0.13
19	300358	楚天科技	2,392,931.00	0.12
20	601003	柳钢股份	2,356,383.00	0.12

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	914,593,841.02
卖出股票收入（成交）总额	869,585,542.13

注：本项中7.4.1、7.4.2、7.4.3表中的"买入金额"（或"买入股票成本"）、"卖出金额"（或"卖出股票收入"）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	161,122,818.13	8.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,410,138,870.86	76.11
	其中：政策性金融债	454,072,224.29	24.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	30,102,513.06	1.62
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,601,364,202.05	86.43

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	260401	26农发01	1,300,000	131,070,273.97	7.07
2	250215	25国开15	1,200,000	118,858,520.55	6.42
3	232380069	23建行二级资本债02A	900,000	95,890,758.90	5.18
4	232380021	23浙商银行二级资本债01	600,000	62,286,588.49	3.36
5	2128042	21兴业银行二级02	600,000	61,799,799.45	3.34

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚。浙商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。华夏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚。

本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和他分析，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司的投资判断未发生改变。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合本基金管理人投资管理制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	115,766.19
2	应收清算款	10,734,103.13
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	211,666.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,061,535.49

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值
---	------	------	------	---------

号				比例（%）
1	113648	巨星转债	2,352,208.22	0.13
2	127049	希望转2	1,628,927.26	0.09
3	123178	花园转债	1,325,957.26	0.07
4	123064	万孚转债	1,119,282.19	0.06
5	127027	能化转债	1,113,498.63	0.06
6	128128	齐翔转2	1,100,608.22	0.06
7	113037	紫银转债	1,098,394.52	0.06
8	132026	G三峡EB2	1,030,132.60	0.06
9	113666	爱玛转债	965,366.58	0.05
10	113054	绿动转债	948,696.77	0.05
11	127041	弘亚转债	944,717.81	0.05
12	128129	青农转债	861,431.23	0.05
13	127084	柳工转2	825,033.70	0.04
14	113042	上银转债	808,685.07	0.04
15	118011	银微转债	798,712.66	0.04
16	123076	强力转债	741,459.59	0.04
17	113661	福22转债	699,432.88	0.04
18	123149	通裕转债	664,016.99	0.04
19	127110	广核转债	658,482.47	0.04
20	113631	皖天转债	656,835.62	0.04
21	113062	常银转债	634,017.12	0.03
22	113056	重银转债	622,839.73	0.03
23	118031	天23转债	606,668.49	0.03
24	110087	天业转债	596,107.81	0.03
25	113053	隆22转债	595,453.56	0.03
26	127045	牧原转债	586,793.84	0.03
27	113052	兴业转债	575,438.22	0.03
28	127078	优彩转债	556,220.38	0.03
29	123183	海顺转债	543,995.07	0.03
30	113058	友发转债	510,987.62	0.03

31	111015	东亚转债	495,524.93	0.03
32	127034	绿茵转债	489,230.68	0.03
33	127040	国泰转债	488,825.32	0.03
34	110093	神马转债	470,005.70	0.03
35	118034	晶能转债	458,106.85	0.02
36	123107	温氏转债	444,088.22	0.02
37	127108	太能转债	373,839.86	0.02
38	111017	蓝天转债	358,924.11	0.02
39	127089	晶澳转债	244,035.29	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
泓德 裕康 债券A	25, 075	46,543.39	677,173,971.68	58.0 2%	489,901,557.91	41.98%
泓德 裕康 债券C	5,9 96	8,509.34	15,776,728.50	30.9 2%	35,245,275.65	69.08%
泓德	10	8,511,104.75	85,039,988.80	99.9	71,058.71	0.08%

裕康 债券D				2%		
合计	31,004	42,033.56	777,990,688.98	59.70%	525,217,892.27	40.30%

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 （份）	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	泓德裕康债券A	301,567.44	0.03%
	泓德裕康债券C	16,610.20	0.03%
	泓德裕康债券D	849.50	0.00%
	合计	319,027.14	0.02%

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泓德裕康债券A	0
	泓德裕康债券C	0~10
	泓德裕康债券D	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	泓德裕康债券A	0~10
	泓德裕康债券C	0
	泓德裕康债券D	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德裕康债券A	泓德裕康债券C	泓德裕康债券D
基金合同生效日(2016年07月15日)基金份额总额	206,660,871.06	466,862.61	-
本报告期期初基金份额总额	1,344,682,192.04	48,014,009.87	-
本报告期基金总申购份额	810,248,148.38	67,140,987.86	106,181,552.50
减：本报告期基金总赎回份额	987,854,810.83	64,132,993.58	21,070,504.99
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,167,075,529.59	51,022,004.15	85,111,047.51

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产的诉讼事项，且无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期未发生公司被中国证监会、基金业协会、证券交易所施以重大处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人高级管理人员及其他从业人员受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	424,881,285.42	23.83%	185,206.61	29.42%	-
东莞证券	2	217,759,030.46	12.21%	40,485.11	6.43%	-

申万宏源证券	2	164,211,490.20	9.21%	71,579.56	11.37%	-
金融街证券	2	157,875,122.01	8.86%	29,346.13	4.66%	-
甬兴证券	2	138,852,020.00	7.79%	60,524.93	9.62%	-
信达证券	1	131,194,320.75	7.36%	57,187.55	9.09%	-
国新证券	2	128,137,213.92	7.19%	23,818.17	3.78%	-
国盛证券	2	116,761,361.40	6.55%	50,895.69	8.09%	-
国投证券	2	101,020,490.28	5.67%	44,032.36	7.00%	-
第一创业证券	2	87,042,935.79	4.88%	16,182.30	2.57%	-
西部证券	1	68,926,449.45	3.87%	30,045.19	4.77%	-
国金证券	0	46,186,108.76	2.59%	20,131.31	3.20%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
东北	2	-	-	-	-	-

证券						
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
国联民生证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- （1）该证券机构经营行为规范，内控制度健全；
- （2）财务状况良好，公司经营状况稳定；
- （3）具有基金投资运作所需的证券服务能力和水平。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后选定证券经营机构；
 - (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订协议。
- 3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：
- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元：无。
 - (2) 本基金报告期内停止租用交易单元：国金证券。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金 额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金 额	占当期 基金成 交总额 的比例
华泰证券	20,285,470.96	24.87%	2,682,385,000.00	48.57%	-	-	-	-
东莞证券	4,572,183.77	5.61%	167,070,000.00	3.03%	-	-	-	-
申万宏源证券	8,073,257.94	9.90%	100,130,000.00	1.81%	-	-	-	-
金融街证券	12,287,884.01	15.07%	472,660,000.00	8.56%	-	-	-	-
甬兴证券	8,486,604.82	10.41%	168,570,000.00	3.05%	-	-	-	-
信达证券	4,652,859.61	5.70%	55,570,000.00	1.01%	-	-	-	-
国新证券	3,461,665.97	4.24%	309,830,000.00	5.61%	-	-	-	-
国盛证券	1,877,540.65	2.30%	458,730,000.00	8.31%	-	-	-	-
国投证券	7,416,768.26	9.09%	678,560,000.00	12.29%	-	-	-	-
第一创业证券	3,943,570.17	4.84%	293,050,000.00	5.31%	-	-	-	-
西部证券	5,345,996.79	6.55%	70,470,000.00	1.28%	-	-	-	-
国金证券	1,157,490.47	1.42%	65,910,000.00	1.19%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泓德基金管理有限公司关于旗下基金参与北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-10
2	泓德基金管理有限公司关于泓德裕康债券型证券投资基金增加D类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-12
3	泓德基金管理有限公司关于泓德裕康债券型证券投资基金D类基金份额开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-12
4	泓德基金管理有限公司关于泓德裕康债券型证券投资基金D类份额新增部分销售机构并参与其费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-23
5	泓德基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31

	年度)		
6	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-22
7	泓德基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-29

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德裕康债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德裕康债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德裕康债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德裕康债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

12.3 查阅方式

- 1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司，客户服务电话：4009-100-888

3、投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.hongdefund.com

泓德基金管理有限公司
二〇二六年八月二十九日